

东方红明远 9 号集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告

资产管理计划管理人：上海东方证券资产管理有限公司

资产管理计划托管人：中国建设银行股份有限公司上海市分行

报告期间：2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日

报告送出日期：2024 年 04 月 30 日

重要提示

本资产管理计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本资产管理计划资产，但不保证本资产管理计划一定盈利。

本资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划合同及说明书。

本报告中财务资料未经审计。

一、基本信息

资产管理计划名称：	东方红明远 9 号集合资产管理计划
合同生效时间：	2019 年 3 月 7 日
管理人：	上海东方证券资产管理有限公司
托管人：	中国建设银行股份有限公司上海市分行

二、资产管理计划投资表现

(一) 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日)
期末资产净值(元)	46,487,696.96
本期利润(元)	-4,451,789.82
期末资产管理计划可分配利润	544,646.46
期末份额净值(元)	1.0119
期末份额累计净值(元)	1.0119
本期资产管理计划净值增长率	-8.06%
资产管理计划累计净值增长率	1.19%

注：本期期末资产管理计划可分配利润和净值未扣除管理人可提取的业绩报酬，以上财务指标不包括参与或退出资产管理计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 资产管理计划累计净值增长率与比较基准收益率的历史走势对比图



注：本资产管理计划无业绩比较基准。

三、资产管理计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

序号	资产类别	金额（元）	占期末总资产的比例（%）
1	权益投资	36,715,655.91	78.52
	其中：境内股票	34,956,355.12	74.75
	港股投资	1,759,300.79	3.76
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款及清算备付金	9,297,455.07	19.88
7	其他资产	748,630.25	1.60
8	资产合计	46,761,741.23	100.00

(二) 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	持仓数量（股）	市值(元)	市值占委托资产净值比例(%)
----	------	------	---------	-------	----------------

1	600557	康缘药业	203,100.00	4,212,294.00	9.06
2	600422	昆药集团	189,800.00	4,082,598.00	8.78
3	000858	五粮液	18,900.00	2,901,339.00	6.24
4	000568	泸州老窖	14,700.00	2,713,473.00	5.84
5	600276	恒瑞医药	58,800.00	2,703,036.00	5.81
6	688331	荣昌生物	33,589.00	1,809,439.43	3.89
6	09995	荣昌生物	28,500.00	701,465.73	1.51
7	600129	太极集团	64,200.00	2,134,650.00	4.59
8	688059	华锐精密	25,552.00	1,582,179.84	3.40
9	601888	中国中免	13,300.00	1,136,086.00	2.44
10	600132	重庆啤酒	17,100.00	1,102,437.00	2.37

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

（三）报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本资产管理计划本报告期末未持有债券。

（四）报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

本资产管理计划本报告期末未持有资产支持证券。

（五）报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名基金明细

本资产管理计划本报告期末未持有基金。

（六）报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名期权明细

本资产管理计划本报告期末未持有期权。

（七）报告期末期货投资情况

本资产管理计划本报告期末未持有期货。

（八）报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名权证明细

本资产管理计划本报告期末未持有权证。

（九）资产管理计划运用杠杆情况

本资产管理计划本报告期末，无因从事证券交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

四、管理人履职报告

（一）投资经理情况

投资经理姓名	学历	证券从业年限	主要工作经历
谭鹏万	复旦大学经济学博士	16 年	上海东方证券资产管理有限公司私募权益投资部总经理、投资经理，复旦大学经济学博士，证券从业 16 年，曾任华宝信托研究员，信诚基金投资部基金经理，中民投国际投资部投研总监，上海东方证券资产管理有限公司投资主办人，私募权益投资部副总经理（主持工作），拥有丰富的证券投资经验。

（二）投资策略回顾与展望

我对经济的判断没有发生改变，种种迹象表明，中国经济正在走出去年下半年的阴霾，尽管复苏还不是很稳固，但持续下行的物价压力有望得到缓解，出口和消费都维持了较好的量增。2024 年有望迎来市场转折之年。尽管悲观情绪还是缠绕在许多投资人的心头，但很多公司的资产负债表和现金流量表都在显著改善，估值处于较低的位置。还有很多公司找到了新常态下的高速增长机会。所以我将以乐观的心态对待 A 股市场，寻找中长期的投资机会。一季度对消费和医药的持仓做了调整和集中，增加了中游制造业如工程机械、轮胎等行业个股的持仓。

（三）公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况的专项说明

本资产管理计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有计划和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

2、异常交易行为的专项说明

报告期内，本资产管理计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合法规规定的要求；交易行为合法合规，未出现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况。

报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 1 次，为指数量化投资组合因跟踪指数需要和其他组合发生的反向交易。

五、托管人履职报告

请参见管理人官网公告的本资产管理计划托管报告。

六、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

（一）资产管理计划管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	180,760.63	235,213.63

注：管理费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：1.50%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每季度支付。

（二）资产管理计划托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	24,101.44	31,361.82

注：托管费计提基准：按前一日计划资产净值；费率：0.20%/年；计提方式：每日计提；支付方式：每季度支付。

（三）业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日	上季度可比期间 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期计提的业绩报酬	-	-

注：业绩报酬计提基准：5.00%；计提方式：区间年化收益率 5%以上计提 20%，分红日最多计提分红金额的 20%；支付方式：本计划分红日、投资者退出日或本计划终止日一次性计提并支付。

本计划业绩报酬的具体计提方法请见本计划合同的相关约定。

七、本报告期资产管理计划投资收益分配情况

单位：人民币元

报告期	每 10 份资产管理计划分红	收益分配合计	备注
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日	-	-	-

八、本报告期涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

（一）投资经理变更

本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。

（二）报告期末产品关联方参与本资产管理计划的情况

项目	持有计划份额总量的数量区间（万份）
管理人董事、监事、从业人员及其配偶参与本计划的情况	0
管理人控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的情况	0
管理人自有资金参与本计划的情况	0
产品其他关联方参与本计划的情况	0

注：数量区间：0、0~50、50~100、100~500、500~1000、1000~2000、>2000。

（三）重大关联交易情况

本报告期内本资产管理计划未发生重大关联交易。

（四）一般关联交易情况

除当期发生的应支付给关联方的管理费、托管费、业绩报酬及产品关联方参与本资产管理计划的情况（如有）外，报告期内本资产管理计划发生以下一般关联交易：

本资产管理计划本报告期内发生的应支付给关联方的佣金总计 39,195.19 元。

（五）其他

本报告期内本资产管理计划无需要说明的其他情况。

上海东方证券资产管理有限公司
2024 年 04 月 30 日